Clearing de Câmbio

Taxas praticadas

Data de contratação	Data de liquidação	Prazo (dias)	Taxa de abertura	Taxa de fechamento	Taxa mínima	Taxa máxima	Cenário de estresse (%)
01/11/2017	01/11/2017	0	3,2751	3,266	3,266	3,266	12,00%
01/11/2017	03/11/2017	1	3,2751	3,2718	3,2629	3,2887	12,00%
01/11/2017	06/11/2017	2	3,2751	3,2724	3,259	3,2896	12,00%

Operações contratadas

Data de contratação	Data de liquidação	Prazo (dias)	Número de Operações	Valor (US$)	Valor (R$)	Taxa média (TCAM)
01/11/2017	01/11/2017	0	1	80.000,00	261.280,00	3,266
01/11/2017	03/11/2017	1	32	487.582.153,87	1.594.475.511,68	3,2702
01/11/2017	06/11/2017	2	83	770.350.211,51	2.520.038.287,28	3,2713
		Totais:	**116**	**1.258.012.365,38**	**4.114.775.078,96**	

Volumes liquidados

Data de liquidação	Prazo (dias)	Situação	Valor (US$)	Valor (R$)
01/11/2017	0	Liquidado	505.889.156,44	1.651.108.041,75
03/11/2017	1	A Liquidar	704.913.110,25	2.306.410.230,03
06/11/2017	2	Previsto	688.945.818,99	2.253.777.679,24

Posição de garantias

	Depositado		Vinculado		% garantias	
Ativo	Quantidade	Volume (R$)	Quantidade	Volume (R$)	vinculadas/depositadas	
Dolar Spot BM&F p/ 1 dia	50.000.000	163.755.000,00	0	0,00	0,00	0,00
LFT	249.658	2.288.505.333,98	36.550	335.200.340,47	29,66	14,65
LTN	3.146.163	2.878.078.186,53	587.062	541.774.076,94	47,94	18,82
NTN-B	464.060	1.490.997.320,41	77.214	247.090.070,25	21,86	16,57
NTN-F	74.209	75.843.487,79	5.870	6.017.197,27	0,53	7,93
Total	**53.934.090**		**706.696**			**16,38**
Total em R$		**6.897.179.328,71**		**1.130.081.684,93**		
Total em US$		**2.105.944.651,68**		**345.052.573,95**		

Dados por canal de negociação

Volumes contratados

Prazo (dias)	Balcão		Pregão Eletrônico	
	US$	R$	US$	R$
0	80.000,00	261.280,00	0,00	0,00
1	487.582.153,87	1.594.475.511,68	0,00	0,00
2	770.350.211,51	2.520.038.287,28	0,00	0,00
Total	**1.258.012.365,38**	**4.114.775.078,96**	**0,00**	**0,00**

Operações contratadas

Prazo (dias)	Balcão	Pregão Eletrônico
0	1	0
1	32	0
2	83	0
Total	**116**	**0**

Taxas praticadas

Prazo (dias)	Balcão			Pregão Eletrônico		
	Mínima	Média	Máxima	Mínima	Média	Máxima
0	3,2660	3,2660	3,2660	0,0000	0,0000	0,0000
1	3,2629	3,2730	3,2887	0,0000	0,0000	0,0000
2	3,2590	3,2711	3,2896	0,0000	0,0000	0,0000